

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	22.61 %	13.74 %	0.10 %	1.52	1.81	1.00	0.18 %	-3.37 %	1.00
GLOBE INDEX II	22.66 %	13.74 %	0.10 %	1.52	2.20	1.00	0.23 %	-3.37 %	1.00
GLOBE INDEX III	22.75 %	13.74 %	0.10 %	1.53	2.92	1.00	0.32 %	-3.36 %	1.00
GLOBE INDEX G	22.77 %	13.74 %	0.10 %	1.53	3.07	1.00	0.34 %	-3.36 %	1.00
MSCI World ex-CH ndr	22.39 %	13.17 %	-	1.57	-	-	-	-3.36 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2023 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	5.76 %	14.47 %	0.09 %	0.28	1.87	1.00	0.18 %	-19.38 %	17.00
GLOBE INDEX II	5.80 %	14.47 %	0.09 %	0.28	2.31	1.00	0.22 %	-19.36 %	17.00
GLOBE INDEX III	5.88 %	14.47 %	0.09 %	0.29	3.10	1.00	0.30 %	-19.31 %	17.00
GLOBE INDEX G	5.89 %	14.47 %	0.09 %	0.29	3.27	1.00	0.32 %	-19.30 %	17.00
MSCI World ex-CH ndr	5.57 %	14.46 %	-	0.27	-	-	-	-19.42 %	17.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2021 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	9.68 %	16.14 %	0.09 %	0.49	2.25	1.00	0.23 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	9.73 %	16.14 %	0.09 %	0.50	2.73	1.00	0.28 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	9.81 %	16.14 %	0.09 %	0.50	3.52	1.00	0.35 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	9.83 %	16.14 %	0.09 %	0.50	3.74	1.00	0.38 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	9.46 %	16.15 %	-	0.48	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2019 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	9.03 %	14.68 %	0.08 %	0.50	2.41	1.00	0.21 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	9.08 %	14.68 %	0.08 %	0.50	3.06	1.00	0.27 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	9.15 %	14.68 %	0.08 %	0.51	3.86	1.00	0.34 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	9.18 %	14.68 %	0.08 %	0.51	4.23	1.00	0.37 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	8.82 %	14.69 %	-	0.49	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2014 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.65 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

Kennzahl	Berechnung	Beschreibung
Volatilität	$\sqrt{\text{Varianz}}$	Durchschnittliche Schwankungen der absoluten Rendite um ihren Mittelwert
Sharpe-Ratio	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.}}{\text{Volatilität Portfolio}}$	Absolute Überschussrendite pro Einheit eingegangenem Gesamtrisiko
Tracking Error	Standardabweichung (Rendite Portfolio p.a. – Rendite Benchmark p.a.)	Durchschnittliche Schwankung der Portfoliorendite um die Benchmarkrendite (Volatilität der relativen Rendite = aktives Risiko) Tracking Error zeigt an, wie benchmarknah ein Vermögen verwaltet wird
Information Ratio	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{Rendite Benchmark p.a.}}{\text{Tracking Error}}$	Mehr- oder Minderrendite pro eingegangenem aktiven Risiko
Beta-Faktor	$\frac{\text{Kovarianz zwischen Rendite Portfolio und Rendite Benchmark}}{\text{Varianz Rendite Benchmark}}$	Übernommenes Marktrisiko / Sensibilität auf Preisveränderungen des Marktes
Jensen-Alpha	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.}}{-\beta \times (\text{Rendite Benchmark p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.})}$	Durchschnittliche risikobereinigte Mehr- oder Minderrendite
Maximum Drawdown (maximaler kumulierter Verlust)	$\frac{\text{Tiefster Portfoliowert nach Kurseinbruch} - \text{Höchster Portfoliowert vorher}}{\text{Höchster Portfoliowert vorher}}$	Maximaler Gesamtverlust innerhalb eines Betrachtungszeitraumes unabhängig von zwischenzeitlichen teilweisen Erholungen
Recovery Period (Erholungsdauer)	$\frac{\text{Datum Wiedererreichung Höchster Portfoliowert} - \text{Datum Tiefster Portfoliowert}}{\text{nach Kurseinbruch gemäss gewählter Periode bei Maximum Drawdown}}$	Zeitdauer bis zur Kompensation des vorangehenden Maximalverlustes
Modified Duration	$\frac{\text{Restlaufzeitgewichteter Barwert der Obligation}}{\text{Barwert der Obligation}}$	Sensitivitätsmass auf Veränderungen des Zinsniveaus